

申万菱信养老目标日期 2040 三年持有 期混合型发起式基金中基金(FOF)清算 报告

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2025 年 08 月 20 日

清算报告公告日：2025 年 09 月 09 日

一、重要提示

申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2022】754 号文注册募集,于 2022 年 8 月 2 日成立并正式运作,本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”),基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定以及《申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产净值低于两亿元的,本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止,无需召开基金份额持有人大会审议,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充时,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

本基金的基金合同生效日为 2022 年 8 月 2 日,基金合同生效之日起三年后的对应日为 2025 年 8 月 2 日。截至 2025 年 8 月 2 日日终,本基金的基金资产规模低于两亿元,触发基金合同约定的上述终止情形,本基金根据约定终止《基金合同》,并于 2025 年 8 月 3 日进入基金财产的清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见 2025 年 8 月 4 日发布在本基金管理人网站 (www.swsmu.com) 和中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn>) 的《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金清算期为 2025 年 08 月 03 日至 2025 年 08 月 20 日, 由基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序, 并由毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙) 对清算报告进行审计, 上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、 基金概况

1、基金基本情况

基金名称	申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
基金简称	申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式 (FOF)
基金代码	015914
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 8 月 2 日
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司

基金托管人	交通银行股份有限公司
最后运作日 (2025 年 8 月 2 日) 基金份额总额	25,299,326.28 份
最后运作日 (2025 年 8 月 2 日) 基金份额净值	1.0207 元

2、基金产品说明

投资目标	本基金是采用目标日期策略的基金中基金，目标日期为 2040 年 12 月 31 日。本基金通过大类资产配置，投资于多种具有不同风险收益特征的基金，并随着目标日期的临近逐步降低权益类资产的配置比例，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金力争通过多层次的大类资产配置体系，合理配置股票、债券、商品等资产，并通过定量和定性相结合的方法精选各类资产下风险收益特征有相对优势的基金产品，构建基金组合，并严控投资过程中的各种风险，力争实现基金资产的稳定回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*X + 上证国债指数收益率*(100%-X)，其中 X 的取值详见《招募说明书》第九部分了解详细情况。
风险收益特征	本基金属于采用目标日期策略的基金中基金，本基金为混合型基金中基金，理论上预期风险与预期收

	益水平低于股票型基金、股票型基金中基金 (FOF) , 高于债券型基金、债券型基金中基金 (FOF) 、货币市场基金和货币型基金中基金 (FOF) 。本基金如果投资港股通标的股票、QDII 基金和香港互认基金, 需承担汇率风险以及境外市场的风险。本基金为目标日期基金中基金, 2040 年 12 月 31 日为本基金的目标日期, 风险和收益水平会随着目标日期的临近而逐步降低。
--	--

三、 基金运作情况概述

申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF) (以下简称“本基金”) , 系经中国证监会证监许可【2022】754 号文《关于准予申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)注册的批复》准予注册, 由基金管理人申万菱信基金管理有限公司向社会公开发行募集, 基金合同于 2022 年 8 月 2 日正式生效, 首次设立募集规模 (含利息结转份额) 为 22,034,211.60 份基金份额, 有效认购户数为 6,758 户。

根据《申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)基金合同》以及《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同终止及基金财产清算的公告》, 自 2025 年 8 月 3 日起本基金进入清算程序, 不再办理本基金的申购、定投、赎回等业务。

四、 财务会计报告

资产负债表 (已经审计)

会计主体: 申万菱信养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金
(FOF)

报告截止日: 2025年8月2日(最后运作日)

资产	本期末 2025年08月02日 (最后运作日)
资产:	
银行存款	2,489,368.95
结算备付金	42,751.09
存出保证金	391.86
交易性金融资产	23,336,931.85
其中: 股票投资	47,940.00
基金投资	22,483,127.63
债券投资	805,864.22
应收清算款	12,283.06
应收股利	32.34
其他资产	40.37
资产总计	25,881,799.52
负债和净资产	
负债:	

应付清算款	0.01
应付管理人报酬	13,830.34
应付托管费	3,320.09
应交税费	444.96
其他负债	40,904.14
负债合计	58,499.54
净资产：	
实收基金	25,299,326.28
未分配利润	523,973.70
净资产合计	25,823,299.98
负债和净资产总计	25,881,799.52

注：1、报告截止日 2025 年 8 月 2 日(最后运作日)，基金份额净值 1.0207 元，基金份额总额 25,299,326.28 份。

2、本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和《基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于 2025 年 08 月 02 日(最后运作日)，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

五、 清算情况

自2025年08月03日至2025年08月20日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，本次清算工作按清算原则和清算手续进行。具体

清算情况如下：

1、清算费用

按照《申万菱信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)基金合同》“第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 42,751.09 元（含应计利息）。其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的交易所最低备付金本金为人民币 2,544.05 元，该款项于 2025 年 8 月 8 日调整为人民币 4,908.16 元，预计将于 2025 年 9 月 8 日划入托管账户。上海港股通备付金本金为人民币 40,205.57 元，该款项已于 2025 年 8 月 4 日划入托管户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 391.86 元（含应计利息），为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金及应计利息，该款项于 2025 年 8 月 4 日调整为人民币 653.09 元，其中 652.92 元，预计将于 2025 年 9 月 2 日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 23,336,931.85 元，其中股票资产为人民币 47,940.00 元，债券资产为人民币 805,864.22 元，基金资产为人民币 22,483,127.63 元，以上资产已最晚于 2025 年 8 月 19 日全部变现，相关证券清算款已最晚于 2025 年 8 月 19 日划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 12,283.06 元，已最晚于 2025 年 8 月 19 日划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收股利为人民币 32.34 元, 已最晚于 2025 年 8 月 19 日划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日其他资产为人民币 40.37 元, 已最晚于 2025 年 8 月 19 日划入托管账户。

3、 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付清算款为人民币 0.01 元, 已于 2025 年 8 月 4 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 13,830.34 元, 已于 2025 年 8 月 19 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,320.09 元, 已于 2025 年 8 月 19 日支付。

(4) 本基金最后运作日应交税费为人民币 444.96 元, 已于 2025 年 8 月 19 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 40,904.14 元, 已最晚于 2025 年 8 月 20 日支付。

4、 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位: 人民币元

项 目	金 额
一、最后运作日2025年08月02日基金净资产	25,823,299.98
加: 清算期间清算净损益	468,504.56
三、2025年08月20日基金净资产	26,291,804.54

资产处置及负债清偿后, 于 2025 年 08 月 20 日本基金剩余财产为人民币 26,291,804.54 元。根据《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信养老目标日

期2040三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同终止及基金财产清算的公告》，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2025年08月20日至本基金最后一笔清算款划出日前一日的货币资金、存出保证金、结算备付金及前述资金产生的利息亦属基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人申万菱信基金管理有限公司将于最后一笔清算款划出日以自有资金垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

5、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 申万菱信养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)资产负债表及审计报告

(2) 关于《申万菱信养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)清算报告》的法律意见书

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

申万菱信养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

基金财产清算小组

2025年09月09日